

NUEVO

# CUANTIFICACIÓN DEL RIESGO

INSCRIPCIÓN

21 DE MAYO

HORAS CPE: 8

TARIFA\*: 760 € · SOCIO: 645 € · SOCIO CORPORATIVO: 530 €

NIVEL: BÁSICO / MEDIO

En un entorno global dominado por cada vez más disponibilidad de datos e información (según la consultora Mckinsey El 90% de los datos no existía hace dos años), la correcta valoración cuantitativa de los riesgos teniendo en cuenta su probabilidad e impacto se vuelven críticos para la función de auditoría interna.

La correcta cuantificación permite a las Direcciones de Auditoría / control interno valorar más correctamente el impacto de los riesgos para dar mayor valor añadido a la función, aportar valor en la confección de mapas de riesgos desde una perspectiva cuantitativa allí donde sea posible y dar valor añadido al resto de la organización valorando económicamente el impacto de los riesgos, las oportunidades y las recomendaciones de auditoría interna".

## OBJETIVOS

Familiarizarse y entender las técnicas de cuantificación de riesgos desde la perspectiva de la función de auditoría interna.

## TEMARIO

### Introducción

- La importancia y las ventajas de la valoración cuantitativa de los riesgos.
- Las diferencias entre valoraciones cualitativas y cuantitativas.

### La cuantificación dentro la función de auditoría interna

- El valor añadido para la función de auditoría interna desde la perspectiva del modelo de tres líneas de defensa (ej.: CFO, Tesorería, gerente de riesgos, auditor interno, etc.).
- Su importancia dentro de los mapas de riesgos y en los trabajos e informes del plan de auditoría interna.

### Cuantificación del apetito al riesgo.

- Tolerancia y capacidad.

### Casos prácticos.

#### Caso 1 - Métodos estadísticos de cuantificación de riesgos: probabilidad e impacto.

- Utilización por el auditor interno para su utilización en:
  - Muestras.
  - Distribuciones de frecuencia.
  - Distribuciones de severidad.
  - Simulación con Montecarlo.
  - Valor en Riesgo – VaR (abreviado a partir de su expresión en inglés "Value at Risk").
  - Herramientas en Excel.

#### Caso 2: Ciber riesgo.

- ¿Es cuantificable el ciber riesgo? Importancia de cuantificar la exposición.
- Metodología existente y su valor añadido para el auditor interno.

## METODOLOGÍA

Los alumnos dispondrán de acceso a las técnicas actuales de cuantificación de riesgos y se le facilitarán referencias y acceso a bibliografía / fuentes de información del curso.

Los casos prácticos irán acompañados de ejemplos e información real.

## DESTINATARIOS

- Auditores internos operativos y de sistemas.
- Profesionales de Control Interno.
- Todas aquellas personas interesadas en la materia.

## DIRECCIÓN TÉCNICA

**Fernando Caballero de la Sen, ROAC, CRMA**  
Managing Director. Aon Global Risk Consulting.

## PONENTES

**Fernando Caballero de la Sen, ROAC, CRMA**  
Managing Director. Aon Global Risk Consulting.

**Marta Grande Esteban, CRMA**  
Directora de ERM / Cumplimiento Normativo. Aon Global Risk Consulting.

**Jonathan Sanchez Porta**  
Colaborador Técnico AREA XXI. Certificación Compliance ASCOM, Internationally Certified Compliance Professional.

**Pablo Montoliu Zunzunegui**  
Chief information & innovation officer. Aon España.

## HORARIO

De 9,00 h. a 18,00 h.

## LUGAR DE CELEBRACIÓN

MADRID · Sede social del IAI (Santa Cruz de Marcenado, 33 - 1º).